

金鹰元安保本混合型证券投资基金 [2016]第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年一月十日

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配等信息,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

基金销售机构在销售基金时,应向投资人说明基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资本基金的招说明书。

本报告期中未发生费用。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	金鹰元安保本混合
基金代码	000110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月11日
报告期末基金资产总额	526,072,604.00
本基金为定期开放型债券型基金,严格控制投资风险,并通过有效的资产配置,力求在控制风险的前提下实现基金资产的长期增值。	
投资目标	本基金在四季度延续以流动管理为主,主要以持有中高等级,中短期期的信用债为主,适当降低杠杆水平,同时,利用货币市场回购工具锁定稳定的利息。
投资策略	本基金在四季度延续以流动管理为主,主要以持有中高等级,中短期期的信用债为主,适当降低杠杆水平,同时,利用货币市场回购工具锁定稳定的利息。
业绩比较基准	业绩比较基准:0.5%+CPI类债券的收益率0.99%10.00%,本基金份额净值增长-1.06%,同期业绩比较基准涨幅为0.53%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险收益特征与股票型基金、混合型基金有显著不同,属于较低风险、低预期收益的基金品种,适合于风险承受能力较低的投资者。
基金经理	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
基金保有人	广州越秀金融控股集团有限公司
下属分级基金的基金简称	金鹰元安保本混合A
下属分级基金的基金代码	000110
报告期末下属分级基金的份额总额	409,749,146.36份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期		(2016年10月11日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	68,040.00	2.本期利润	1,717,403.74
2.本期末利润	-1,231,043.09	3.期末可供分配利润	-6,077,894.56
4.期末基金份额净值	0.9981	5.期末基金份额总额	-0.0004
6.期末基金份额净值	1.0248	7.期末可供分配利润	0.0010
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;	2.本期可供分配利润指期末资产扣除非利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为零,不是当期发生数);	3.期末可供分配利润,指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为零,不是当期发生数);	4.本基金的业绩比较基准为:2年期银行定期存款利率(税后)。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

注:1.本基金合同生效日期为2013年5月20日,2016年3月10日新增元安保本C份额,原来份额为元安保本A份额。

2.本基金A份额于2015年5月28日起转入第二个保本期运作,各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.本基金的业绩比较基准为:2年期银行定期存款利率(税后)。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

报告期内,公司严格按照法律法规、《基金合同》及《招募说明书》的规定,履行了信息披露、基金募集、基金估值、基金申购赎回、基金转换、基金分红派息、基金费用计提、基金信息披露、基金宣传推介、基金客户服务、基金销售等各项业务,没有损害基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内本基金的估值政策和定价依据

4.5 报告期内本基金的组合投资情况

4.6 报告期内本基金的关联交易情况

4.7 报告期内本基金的证券投资运作情况

4.8 报告期内本基金的理财计划投资运作情况

4.9 报告期内本基金的套利交易情况

4.10 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.11 报告期内本基金的转融通交易情况

4.12 报告期内本基金的国债期货交易情况

4.13 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.14 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.15 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.16 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.17 报告期内本基金的转融通交易情况

4.18 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.19 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.20 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.21 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.22 报告期内本基金的转融通交易情况

4.23 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.24 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.25 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.26 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.27 报告期内本基金的转融通交易情况

4.28 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.29 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.30 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.31 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.32 报告期内本基金的转融通交易情况

4.33 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.34 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.35 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.36 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.37 报告期内本基金的转融通交易情况

4.38 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.39 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.40 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.41 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.42 报告期内本基金的转融通交易情况

4.43 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.44 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.45 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.46 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.47 报告期内本基金的转融通交易情况

4.48 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.49 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.50 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.51 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.52 报告期内本基金的转融通交易情况

4.53 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.54 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.55 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.56 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.57 报告期内本基金的转融通交易情况

4.58 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.59 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.60 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.61 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.62 报告期内本基金的转融通交易情况

4.63 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.64 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.65 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.66 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.67 报告期内本基金的转融通交易情况

4.68 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.69 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.70 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.71 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.72 报告期内本基金的转融通交易情况

4.73 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.74 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.75 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.76 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.77 报告期内本基金的转融通交易情况

4.78 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.79 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.80 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.81 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.82 报告期内本基金的转融通交易情况

4.83 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.84 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.85 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.86 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.87 报告期内本基金的转融通交易情况

4.88 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.89 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.90 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.91 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.92 报告期内本基金的转融通交易情况

4.93 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.94 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.95 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.96 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.97 报告期内本基金的转融通交易情况

4.98 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.99 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.10 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.11 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.12 报告期内本基金的转融通交易情况

4.13 报告期内本基金的国债期货投资情况

4.14 报告期内本基金的资产支持证券投资情况

4.15 报告期内本基金的股指期货交易情况

4.16 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.17 报告期内本基金的转融通交易情况